

# 中欧滚钱宝发起式货币市场基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 14        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 14        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 14        |
| 6.2 利润表                                 | 16        |
| 6.3 净资产变动表                              | 17        |
| 6.4 报表附注                                | 19        |
| <b>§7 投资组合报告</b>                        | <b>38</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 38        |
| 7.2 债券回购融资情况                            | 39        |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限                        | 39        |
| 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明         | 40        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 40        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细      | 40        |
| 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离      | 41        |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细  | 41        |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 7.9 投资组合报告附注 .....                       | 41        |
| <b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>                | <b>42</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 42        |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....             | 43        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 43        |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....   | 43        |
| 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                | 43        |
| <b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>                | <b>43</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                  | <b>44</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 44        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....   | 44        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 44        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 44        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 44        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....       | 45        |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 .....   | 45        |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....              | 46        |
| 10.9 其他重大事件 .....                        | 46        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>          | <b>47</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 ..... | 47        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 47        |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                  | <b>47</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 47        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 47        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 47        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                      |                |                  |
|-----------------|----------------------|----------------|------------------|
| 基金名称            | 中欧滚钱宝发起式货币市场基金       |                |                  |
| 基金简称            | 中欧滚钱宝货币              |                |                  |
| 基金主代码           | 001211               |                |                  |
| 基金运作方式          | 契约型、开放式、发起式          |                |                  |
| 基金合同生效日         | 2015 年 6 月 12 日      |                |                  |
| 基金管理人           | 中欧基金管理有限公司           |                |                  |
| 基金托管人           | 中国民生银行股份有限公司         |                |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 153,653,765,720.74 份 |                |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期                  |                |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 中欧滚钱宝货币 A            | 中欧滚钱宝货币 B      | 中欧滚钱宝货币 C        |
| 下属分级基金的交易代码     | 001211               | 004938         | 004939           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 153,492,893,448.98 份 | 5,914,909.08 份 | 154,957,362.68 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                   |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在综合考虑基金资产收益性、安全性和较高流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的稳定收益。                                                       |
| 投资策略   | 本基金根据对短期利率变动的预测，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用定性分析和定量分析方法，通过对短期金融工具的积极投资，在控制风险和保证流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。 |
| 业绩比较基准 | 同期 7 天通知存款税后利率                                                                                    |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。                                                    |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                                    | 基金托管人              |
|---------|------|------------------------------------------|--------------------|
| 名称      |      | 中欧基金管理有限公司                               | 中国民生银行股份有限公司       |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 黎忆海                                      | 林盛                 |
|         | 联系电话 | 021-68609600                             | 010-58560666       |
|         | 电子邮箱 | liyihai@zofund.com                       | tgxxpl@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 021-68609700、400-700-9700                | 95568              |
| 传真      |      | 021-50190017                             | 010-57093382       |
| 注册地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层             | 北京市西城区复兴门内大街 2 号   |
| 办公地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层 | 北京市西城区复兴门内大街 2 号   |

|       |        |        |
|-------|--------|--------|
| 邮政编码  | 200120 | 100031 |
| 法定代表人 | 窦玉明    | 高迎欣    |

## 2.4 信息披露方式

|                   |                |
|-------------------|----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 证券时报           |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | www.zofund.com |
| 基金中期报告置备地点        | 基金管理人的办公场所     |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                                         |
|--------|------------|----------------------------------------------|
| 注册登记机构 | 中欧基金管理有限公司 | 中国（上海）自由贸易试验区<br>陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层 |

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日) |              |                |
|---------------|---------------------------------------|--------------|----------------|
|               | 中欧滚钱宝货币 A                             | 中欧滚钱宝货币 B    | 中欧滚钱宝货币 C      |
| 本期已实现收益       | 787,907,364.76                        | 37,301.21    | 760,023.25     |
| 本期利润          | 787,907,364.76                        | 37,301.21    | 760,023.25     |
| 本期净值收益率       | 0.5145%                               | 0.6342%      | 0.5145%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)                 |              |                |
|               | 期末基金资产净值                              | 期末基金资产净值     | 期末基金资产净值       |
| 期末基金资产净值      | 153,492,893,448.98                    | 5,914,909.08 | 154,957,362.68 |
| 期末基金份额净值      | 1.0000                                | 1.0000       | 1.0000         |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)                 |              |                |
|               | 累计净值收益率                               | 累计净值收益率      | 累计净值收益率        |
| 累计净值收益率       | 29.6715%                              | 23.7502%     | 21.1052%       |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣

除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益等。

2、本基金利润分配按日结转份额。

3、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧滚钱宝货币 A

| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③      | ②－④     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去三个月      | 0.2522%  | 0.0003%     | 0.3366%    | 0.0000%       | -0.0844% | 0.0003% |
| 过去六个月      | 0.5145%  | 0.0003%     | 0.6695%    | 0.0000%       | -0.1550% | 0.0003% |
| 过去一年       | 1.0778%  | 0.0004%     | 1.3500%    | 0.0000%       | -0.2722% | 0.0004% |
| 过去三年       | 4.3727%  | 0.0013%     | 4.0500%    | 0.0000%       | 0.3227%  | 0.0013% |
| 过去五年       | 8.2542%  | 0.0012%     | 6.7500%    | 0.0000%       | 1.5042%  | 0.0012% |
| 过去七年       | 13.0898% | 0.0014%     | 9.4500%    | 0.0000%       | 3.6398%  | 0.0014% |
| 过去十年       | 25.4140% | 0.0026%     | 13.4981%   | 0.0000%       | 11.9159% | 0.0026% |
| 自基金合同生效起至今 | 29.6715% | 0.0032%     | 14.9203%   | 0.0000%       | 14.7512% | 0.0032% |

注： 本基金收益分配按日结转份额

中欧滚钱宝货币 B

| 阶段 | 份额净值收益 | 份额净值收益率标 | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差 | ①－③ | ②－④ |
|----|--------|----------|----------------|------------------|-----|-----|
|----|--------|----------|----------------|------------------|-----|-----|

|                  | 率①           | 准差②     |          | ④       |              |             |
|------------------|--------------|---------|----------|---------|--------------|-------------|
| 过去三个月            | 0.3122%      | 0.0003% | 0.3366%  | 0.0000% | -0.024<br>4% | 0.0003<br>% |
| 过去六个月            | 0.6342%      | 0.0003% | 0.6695%  | 0.0000% | -0.035<br>3% | 0.0003<br>% |
| 过去一年             | 1.3206%      | 0.0004% | 1.3500%  | 0.0000% | -0.029<br>4% | 0.0004<br>% |
| 过去三年             | 5.1266%      | 0.0013% | 4.0500%  | 0.0000% | 1.0766<br>%  | 0.0013<br>% |
| 过去五年             | 9.5609%      | 0.0012% | 6.7500%  | 0.0000% | 2.8109<br>%  | 0.0012<br>% |
| 过去七年             | 15.0054<br>% | 0.0014% | 9.4500%  | 0.0000% | 5.5554<br>%  | 0.0014<br>% |
| 自基金份额起始运<br>作日至今 | 23.7502<br>% | 0.0025% | 12.1056% | 0.0000% | 11.644<br>6% | 0.0025<br>% |

注： 本基金收益分配按日结转份额

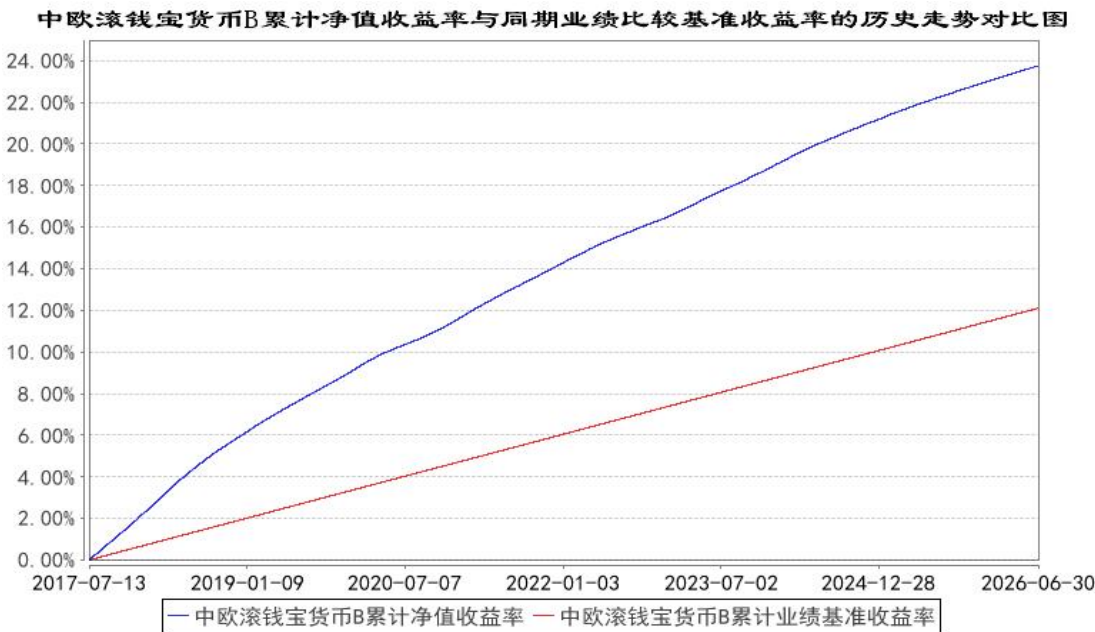
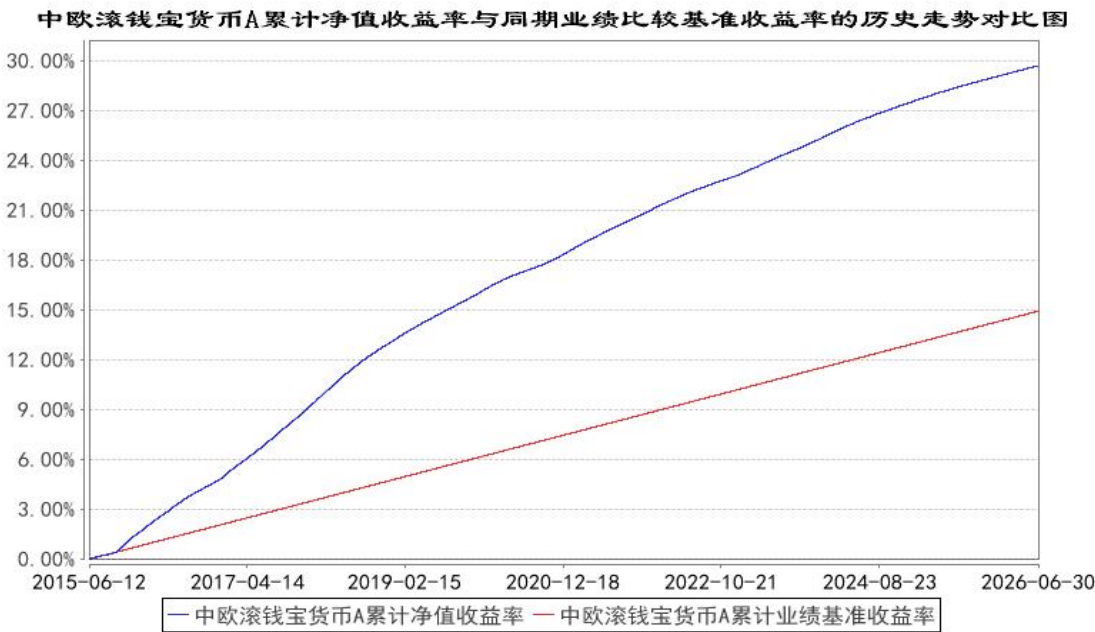
中欧滚钱宝货币 C

| 阶段    | 份额净<br>值收益<br>率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①－③          | ②－④         |
|-------|------------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------------|-------------|
| 过去三个月 | 0.2522%          | 0.0003%             | 0.3366%        | 0.0000%               | -0.084<br>4% | 0.0003<br>% |
| 过去六个月 | 0.5145%          | 0.0003%             | 0.6695%        | 0.0000%               | -0.155<br>0% | 0.0003<br>% |
| 过去一年  | 1.0780%          | 0.0004%             | 1.3500%        | 0.0000%               | -0.272<br>0% | 0.0004<br>% |
| 过去三年  | 4.3728%          | 0.0013%             | 4.0500%        | 0.0000%               | 0.3228<br>%  | 0.0013<br>% |
| 过去五年  | 8.2541%          | 0.0012%             | 6.7500%        | 0.0000%               | 1.5041<br>%  | 0.0012<br>% |

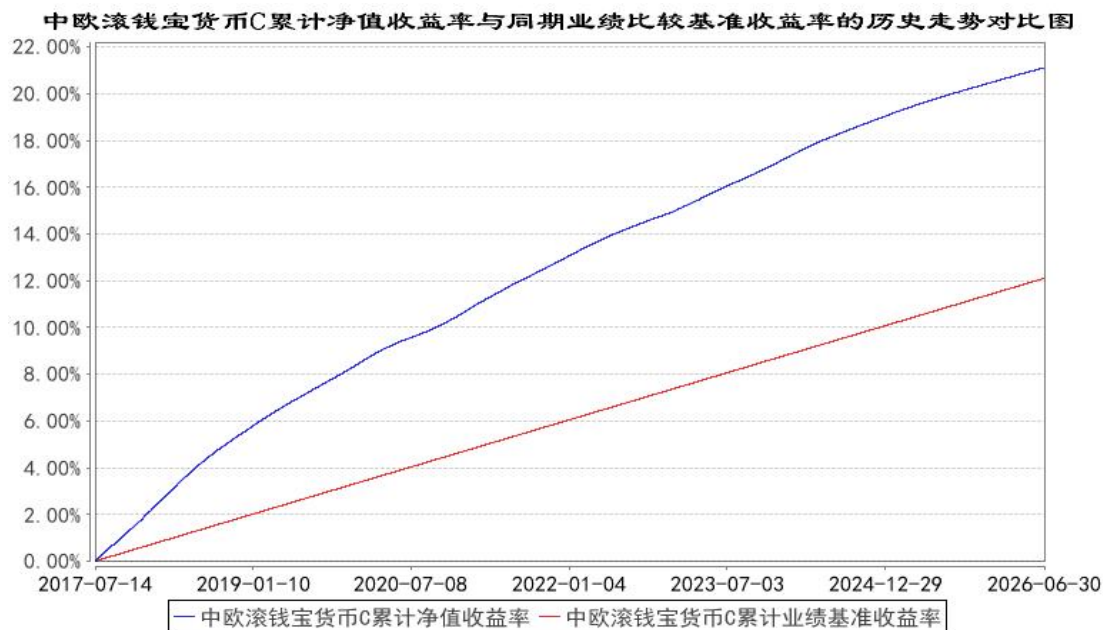
|                  |              |         |          |         |             |             |
|------------------|--------------|---------|----------|---------|-------------|-------------|
| 过去七年             | 13.0897<br>% | 0.0014% | 9.4500%  | 0.0000% | 3.6397<br>% | 0.0014<br>% |
| 自基金份额起始运<br>作日至今 | 21.1052<br>% | 0.0025% | 12.1019% | 0.0000% | 9.0033<br>% | 0.0025<br>% |

注： 本基金收益分配按日结转份额

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：自 2017 年 7 月 12 日起, 本基金增加 B 份额。图示日期为 2017 年 7 月 13 日至 2026 年 06 月 30 日。



注：自 2017 年 7 月 12 日起，本基金增加 C 份额。图示日期为 2017 年 7 月 14 日至 2026 年 06 月 30 日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司、中欧基金国际有限公司和中欧私募基金管理（上海）有限公司。截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 243 只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务   | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                             |
|-----|------|-----------------|------|--------|--------------------------------------------------------------------------------|
|     |      | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                |
| 张东波 | 基金经理 | 2022-09-30      | —    | 11 年   | 历任东海证券股份有限公司固定收益部债券交易员，中山证券有限责任公司资管事业部投资主办助理。2017-09-28 加入中欧基金管理有限公司，历任基金经理助理。 |
| 杨琳  | 基金经理 | 2026-06-        | —    | 1 年    | 历任全国银行间同业拆借中心市场二部                                                              |

|     |               |            |            |      |                                                                                         |
|-----|---------------|------------|------------|------|-----------------------------------------------------------------------------------------|
| 琳   | 助理            | 08         |            |      | 经理，长江证券研究所宏观利率高级分析师，上海申银万国证券研究所宏观配置研究中心债券研究团队高级分析师。2026-02-25 加入中欧基金管理有限公司。             |
| 管志玉 | 基金经理 / 基金经理助理 | 2024-01-11 | 2026-06-08 | 17 年 | 历任博时基金管理有限公司交易员，西南证券股份有限公司投资经理，开源证券股份有限公司投资主办，建信理财有限责任公司高级投资经理。2023-09-18 加入中欧基金管理有限公司。 |

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中管志玉自 2024 年 1 月 11 日起至 2026 年 6 月 8 日担任本基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

本报告期内，本基金管理人公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 9 次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，我国经济运行呈现“平稳开局、二季度小幅走弱”的特征，整体延续温和修复态势，但复苏斜率有所放缓。上半年国内生产总值（GDP）累计同比增长 4.7%，较 2025 年全年 5.0% 的增速回落 0.3 个百分点。货币政策坚持适度宽松导向，央行通过多种流动性工具组合维持资金面稳健充裕，为实体经济修复和债券市场平稳运行提供了良好的流动性环境。债券市场收益率整体延续下行趋势，10 年期国债收益率从年初的 1.85% 附近下行至 6 月末的 1.73%，同业存单收益率则先降后稳，走出了“上半年持续下行、二季度末企稳小幅回升”的行情。

一季度 GDP 当季同比增长 5.0%，累计同比亦为 5.0%，为全年经济打下了较为稳健的基础。价格端，一季度 PPI 同比为 1 月-1.4%、2 月-0.9%、3 月+0.5%，呈现逐月收窄并于 3 月转正的态势；CPI 同比在 0.2% 至 1.3% 的低位徘徊，通胀压力总体温和。消费端 3 月社零当月同比回升至 1.7%，为上半年高点，显示春节后消费有所回暖。央行延续适度宽松基调，7 天逆回购操作利率维持在 1.40% 不变，作为政策利率锚定资金面中枢。中期借贷便利（MLF）方面，央行加大了中期流动性投放力度以对冲跨年及春节资金需求：1 月 MLF 投放 9000 亿元、净投放高达 7000 亿元，为上半年单月投放峰值；2 月投放 6000 亿元、净投放 3000 亿元；3 月投放 5000 亿元、净投放 500 亿元。一季度 MLF 累计净投放约 1.05 万亿元，充分体现了央行在开年阶段“充裕供给、稳定预期”的操作意图。总体看，一季度流动性维持宽裕，配合国债、地方债发行节奏，央行通过短端逆回购灵活校准、中端 MLF 补充的方式，保持了资金面的整体稳健。1 年期 AAA 级同业存单收益率呈现震荡下行走势，年初 1 月中旬一度处于 1.635% 的相对高位，随后在流动性宽松环境下稳步回落，2 月末降至 1.58% 附近，3 月末进一步下行至 1.51%，一季度累计下行约 12BP。存单收益率的下行既反映了资金面的持续宽松，也体现出银行负债端成本压力的边际缓解。

二季度 GDP 当季同比回落至 4.3%，较一季度下降 0.7 个百分点，是上半年经济走弱最直接的体现。价格端出现“PPI 快速上行、CPI 维持温和”的分化：PPI 同比从 4 月的 2.8% 升至 5 月的 3.9%、6 月的 4.1%，工业品价格加速修复；CPI 则稳定在 1.0% 至 1.2% 区间。消费端表现偏弱，4 月社零当月同比仅 0.2%，5 月转负至-0.6%，6 月回升至 1.0%，居民消费仍显疲弱，是二季度内需走弱的重要拖累项。二季度央行继续维持适度宽松，7 天逆回购利率全季保持 1.40% 不变。MLF 操作方面，4 月投放 4000 亿元，但由于到期量较大，当月转为净回笼 2000 亿元，是上半年唯一净回笼的月份；5 月投放 6000 亿元、净投放 1000 亿元；6 月投放 5000 亿元、净投放 2000 亿元。二季度 MLF 累计净投放约 1000 亿元，投放力度较一季度明显收敛，反映出在跨年、春节流动性缺口消退后，央行操作回归常态化、精准化。值得注意的是，二季度部分时段出现 7 天逆回购地量投

放、DR007 与政策利率倒挂、短端市场利率持续低于政策利率的现象，反映资金面持续宽裕的同时，央行对流动性边际收敛也有所显现，呵护与校准并存。1 年期 AAA 同业存单收益率延续下行并于季末企稳回升。4 月末降至 1.445%，5 月末进一步下探至 1.43% 附近，创上半年新低；进入 6 月后，受季末资金面扰动、存单供给放量等因素影响，收益率小幅回升，6 月末回升至 1.4625%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 0.5145%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%；基金 B 类份额净值增长率为 0.6342%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%；基金 C 类份额净值增长率为 0.5145%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，下半年经济有望在政策支持下维持温和修复，但复苏斜率或仍受内需偏弱、外部环境复杂化的双重约束。一方面，PPI 同比转正且斜率较陡，短期通胀上行风险有所积累，输入型通胀与大宗商品价格波动值得关注；另一方面，消费修复偏缓、房地产仍在筑底，经济内生动能尚待进一步夯实。预计货币政策将延续适度宽松基调，坚持总量政策与结构性工具协同；考虑到短期通胀抬头和外部掣肘，全面降准降息或保持谨慎、相机而动，具体时点有待三季度经济与通胀数据指引；结构性货币政策工具（科技金融、绿色金融、普惠金融等）或将成为政策发力的主要抓手，实现精准滴灌。流动性管理上，央行预计延续“长短结合、灵活适度”模式，依靠国债买卖、MLF、买断式逆回购补充中长期流动性，通过逆回购校准短端资金面，资金面料将维持稳健充裕。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、战略规划及业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL 形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金

合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内进行了利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。详见下述报告中“利润分配情况”。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“关联方证券出借”、“各关联方投资本基金的情况”、“关联方承销证券”和“金融工具风险及管理”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：中欧滚钱宝发起式货币市场基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 | 上年度末 |
|-----|-----|-----|------|
|-----|-----|-----|------|

|               |            | 2026 年 6 月 30 日                | 2025 年 12 月 31 日                 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产:</b>   |            |                                |                                  |
| 货币资金          | 6. 4. 7. 1 | 60, 891, 678, 871. 26          | 42, 485, 087, 584. 83            |
| 结算备付金         |            | -                              | 101, 532. 38                     |
| 存出保证金         |            | 207, 748. 83                   | 58, 797. 61                      |
| 交易性金融资产       | 6. 4. 7. 2 | 69, 686, 253, 072. 47          | 93, 170, 860, 193. 47            |
| 其中: 股票投资      |            | -                              | -                                |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | 69, 686, 253, 072. 47          | 93, 170, 860, 193. 47            |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资         |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产        | 6. 4. 7. 3 | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产      | 6. 4. 7. 4 | 32, 151, 200, 905. 95          | 16, 016, 605, 203. 28            |
| 债权投资          |            | -                              | -                                |
| 其中: 债券投资      |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 其他债权投资        |            | -                              | -                                |
| 其他权益工具投资      |            | -                              | -                                |
| 应收清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 24, 741. 48                    | 585, 404. 39                     |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6. 4. 7. 5 | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 162, 729, 365, 339. 99         | 151, 673, 298, 715. 96           |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2025 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债:</b>   |            |                                |                                  |
| 短期借款          |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债       |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债        | 6. 4. 7. 3 | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | 9, 000, 356, 079. 56           | 2, 339, 094, 822. 91             |
| 应付清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款         |            | 156, 467. 62                   | 1, 210. 03                       |
| 应付管理人报酬       |            | 35, 512, 788. 82               | 35, 609, 900. 43                 |
| 应付托管费         |            | 6, 341, 569. 42                | 6, 358, 910. 79                  |
| 应付销售服务费       |            | 31, 706, 680. 97               | 31, 793, 067. 38                 |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | 21, 740. 84                    | 57, 260. 64                      |
| 应付利润          |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债       |            | -                              | -                                |
| 其他负债          | 6. 4. 7. 6 | 1, 504, 292. 02                | 746, 164. 10                     |

|             |         |                    |                    |
|-------------|---------|--------------------|--------------------|
| 负债合计        |         | 9,075,599,619.25   | 2,413,661,336.28   |
| <b>净资产：</b> |         |                    |                    |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 153,653,765,720.74 | 149,259,637,379.68 |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | -                  | -                  |
| 净资产合计       |         | 153,653,765,720.74 | 149,259,637,379.68 |
| 负债和净资产总计    |         | 162,729,365,339.99 | 151,673,298,715.96 |

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 153,653,765,720.74 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.0000 元，基金份额总额 153,492,893,448.98 份；下属 B 类基金份额净值为人民币 1.0000 元，基金份额总额 5,914,909.08 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.0000 元，基金份额总额 154,957,362.68 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧滚钱宝发起式货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年<br>6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年<br>6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>        |          | 1,290,612,410.41                         | 1,244,693,053.75                              |
| 1. 利息收入               |          | 683,356,874.31                           | 594,472,987.16                                |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.9  | 505,677,981.88                           | 353,197,598.97                                |
| 债券利息收入                |          | -                                        | -                                             |
| 资产支持证券利息收入            |          | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入            |          | 177,678,892.43                           | 241,275,388.19                                |
| 其他利息收入                |          | -                                        | -                                             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）     |          | 607,255,536.10                           | 650,220,066.59                                |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.10 | -                                        | -                                             |
| 基金投资收益                |          | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                | 6.4.7.11 | 607,255,536.10                           | 650,220,066.59                                |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.12 | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益               |          | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.13 | -                                        | -                                             |
| 股利收益                  | 6.4.7.14 | -                                        | -                                             |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 |          | -                                        | -                                             |
| 其他投资收益                |          | -                                        | -                                             |
| 3. 公允价值变动收益           | 6.4.7.15 | -                                        | -                                             |

|                     |             |                   |                   |
|---------------------|-------------|-------------------|-------------------|
| (损失以“-”号填列)         |             |                   |                   |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)  |             | -                 | -                 |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列)  | 6. 4. 7. 16 | -                 | -                 |
| 减：二、营业总支出           |             | 501, 907, 721. 19 | 387, 864, 691. 83 |
| 1. 管理人报酬            |             | 213, 448, 616. 85 | 183, 657, 699. 41 |
| 2. 托管费              |             | 38, 115, 824. 41  | 32, 796, 017. 71  |
| 3. 销售服务费            |             | 190, 572, 099. 81 | 163, 973, 174. 09 |
| 4. 投资顾问费            |             | -                 | -                 |
| 5. 利息支出             |             | 59, 466, 454. 35  | 7, 177, 068. 81   |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |             | 59, 466, 454. 35  | 7, 177, 068. 81   |
| 6. 信用减值损失           | 6. 4. 7. 17 | -                 | -                 |
| 7. 税金及附加            |             | 39, 589. 50       | 42, 455. 43       |
| 8. 其他费用             | 6. 4. 7. 18 | 265, 136. 27      | 218, 276. 38      |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) |             | 788, 704, 689. 22 | 856, 828, 361. 92 |
| 减：所得税费用             |             | -                 | -                 |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列)   |             | 788, 704, 689. 22 | 856, 828, 361. 92 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |             | -                 | -                 |
| 六、综合收益总额            |             | 788, 704, 689. 22 | 856, 828, 361. 92 |

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧滚钱宝发起式货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |        |                   |                            |
|----------------------|---------------------------------------|--------|-------------------|----------------------------|
|                      | 实收基金                                  | 其他综合收益 | 未分配利润             | 净资产合计                      |
| 一、上期期末净资产            | 149, 259, 637, 37<br>9. 68            | -      | -                 | 149, 259, 637, 379<br>. 68 |
| 二、本期期初净资产            | 149, 259, 637, 37<br>9. 68            | -      | -                 | 149, 259, 637, 379<br>. 68 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 4, 394, 128, 341.<br>06               | -      | -                 | 4, 394, 128, 341. 0<br>6   |
| (一)、综合收益总额           | -                                     | -      | 788, 704, 689. 22 | 788, 704, 689. 22          |

|                                          |                                            |        |                 |                     |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|-----------------|---------------------|
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | 4,394,128,341.06                           | -      | -               | 4,394,128,341.06    |
| 其中：1. 基金申购款                              | 692,573,771,405.20                         | -      | -               | 692,573,771,405.20  |
| 2. 基金赎回款                                 | -688,179,643,064.14                        | -      | -               | -688,179,643,064.14 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                                          | -      | -788,704,689.22 | -788,704,689.22     |
| 四、本期期末净资产                                | 153,653,765,720.74                         | -      | -               | 153,653,765,720.74  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |        |                 |                     |
|                                          | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润           | 净资产合计               |
| 一、上期期末净资产                                | 125,427,595,974.51                         | -      | -               | 125,427,595,974.51  |
| 二、本期期初净资产                                | 125,427,595,974.51                         | -      | -               | 125,427,595,974.51  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 7,716,103,208.29                           | -      | -               | 7,716,103,208.29    |
| (一)、综合收益总额                               | -                                          | -      | 856,828,361.92  | 856,828,361.92      |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | 7,716,103,208.29                           | -      | -               | 7,716,103,208.29    |
| 其中：1. 基金申购款                              | 556,146,777,811.96                         | -      | -               | 556,146,777,811.96  |
| 2. 基金赎回款                                 | -548,430,674,6                             | -      | -               | -548,430,674,60     |

|                                          |                        |   |                    |                        |
|------------------------------------------|------------------------|---|--------------------|------------------------|
|                                          | 03. 67                 |   |                    | 3. 67                  |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                      | - | -856, 828, 361. 92 | -856, 828, 361. 92     |
| 四、本期期末净资产                                | 133, 143, 699, 182. 80 | - | -                  | 133, 143, 699, 182. 80 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建平王音然李宝林

基金管理人负责人主管会计工作负责人会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧滚钱宝发起式货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]476 号《关于准予中欧滚钱宝发起式货币市场基金注册的批复》核准，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 40,000,000.00 元，经向中国证监会备案，《中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金合同》于 2015 年 06 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 40,000,000.00 份基金份额，募集期间未产生利息。本基金为发起式基金。基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等投资管理人员认购金额不低于 1,000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年。本基金最新情况见 2. 基金简介。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号〈

货币市场基金信息披露特别规定》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 1. 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债

券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

2. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

3. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 3,128,099,083.61       |
| 等于：本金          | 3,120,926,633.51       |
| 加：应计利息         | 7,172,450.10           |
| 减：坏账准备         | —                      |
| 定期存款           | 57,763,579,787.65      |
| 等于：本金          | 57,600,000,000.00      |
| 加：应计利息         | 163,579,787.65         |
| 减：坏账准备         | —                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | 5,001,041,875.00       |
| 存款期限 1-3 个月    | 6,702,564,618.08       |
| 存款期限 3 个月以上    | 46,059,973,294.57      |
| 其他存款           | —                      |
| 等于：本金          | —                      |

|        |                   |
|--------|-------------------|
| 加：应计利息 | -                 |
| 减：坏账准备 | -                 |
| 合计     | 60,891,678,871.26 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |                   |               |         |
|--------|-------|------------------------|-------------------|---------------|---------|
|        |       | 按实际利率计算的账面价值           | 影子定价              | 偏离金额          | 偏离度(%)  |
| 债券     | 交易所市场 | 51,166,628.66          | 51,007,800.00     | -158,828.66   | -0.0001 |
|        | 银行间市场 | 69,635,086,443.81      | 69,649,099,028.40 | 14,012,584.59 | 0.0091  |
|        | 合计    | 69,686,253,072.47      | 69,700,106,828.40 | 13,853,755.93 | 0.0090  |
| 资产支持证券 |       | -                      | -                 | -             | -       |
| 合计     |       | 69,686,253,072.47      | 69,700,106,828.40 | 13,853,755.93 | 0.0090  |

注：1、偏离金额 = 影子定价 - 按实际利率计算的账面价值；

2、偏离度 = 偏离金额 / 通过按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                      | -         |
| 银行间市场 | 32,151,200,905.95      | -         |
| 合计    | 32,151,200,905.95      | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 其他资产

无。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |

|            |              |
|------------|--------------|
| 应付赎回费      | -            |
| 应付证券出借违约金  | -            |
| 应付交易费用     | 1,386,342.24 |
| 其中：交易所市场   | -            |
| 银行间市场      | 1,386,342.24 |
| 应付利息       | -            |
| 预提费用-信息披露费 | 59,507.37    |
| 预提费用-审计费   | 49,588.57    |
| 预提费用-账户维护费 | 8,853.84     |
| 合计         | 1,504,292.02 |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 中欧滚钱宝货币 A

| 项目            | 本期                              |                     |
|---------------|---------------------------------|---------------------|
|               | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                     |
|               | 基金份额（份）                         | 账面金额                |
| 上年度末          | 149,110,340,564.89              | 149,110,340,564.89  |
| 本期申购          | 692,407,422,266.24              | 692,407,422,266.24  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -688,024,869,382.15             | -688,024,869,382.15 |
| 本期末           | 153,492,893,448.98              | 153,492,893,448.98  |

##### 中欧滚钱宝货币 B

| 项目            | 本期                              |              |
|---------------|---------------------------------|--------------|
|               | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |              |
|               | 基金份额（份）                         | 账面金额         |
| 上年度末          | 5,875,602.22                    | 5,875,602.22 |
| 本期申购          | 50,569.25                       | 50,569.25    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -11,262.39                      | -11,262.39   |
| 本期末           | 5,914,909.08                    | 5,914,909.08 |

##### 中欧滚钱宝货币 C

| 项目            | 本期                              |                 |
|---------------|---------------------------------|-----------------|
|               | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                         | 账面金额            |
| 上年度末          | 143,421,212.57                  | 143,421,212.57  |
| 本期申购          | 166,298,569.71                  | 166,298,569.71  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -154,762,419.60                 | -154,762,419.60 |
| 本期末           | 154,957,362.68                  | 154,957,362.68  |

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

##### 中欧滚钱宝货币 A

| 项目   | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|------|-------|-------|---------|
| 上年度末 | -     | -     | -       |

|                |                 |   |                 |
|----------------|-----------------|---|-----------------|
| 本期期初           | -               | - | -               |
| 本期利润           | 787,907,364.76  | - | 787,907,364.76  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -               | - | -               |
| 其中：基金申购款       | -               | - | -               |
| 基金赎回款          | -               | - | -               |
| 本期已分配利润        | -787,907,364.76 | - | -787,907,364.76 |
| 本期末            | -               | - | -               |

中欧滚钱宝货币 B

| 项目             | 已实现部分      | 未实现部分 | 未分配利润合计    |
|----------------|------------|-------|------------|
| 上年度末           | -          | -     | -          |
| 本期期初           | -          | -     | -          |
| 本期利润           | 37,301.21  | -     | 37,301.21  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -          | -     | -          |
| 其中：基金申购款       | -          | -     | -          |
| 基金赎回款          | -          | -     | -          |
| 本期已分配利润        | -37,301.21 | -     | -37,301.21 |
| 本期末            | -          | -     | -          |

中欧滚钱宝货币 C

| 项目             | 已实现部分       | 未实现部分 | 未分配利润合计     |
|----------------|-------------|-------|-------------|
| 上年度末           | -           | -     | -           |
| 本期期初           | -           | -     | -           |
| 本期利润           | 760,023.25  | -     | 760,023.25  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -           | -     | -           |
| 其中：基金申购款       | -           | -     | -           |
| 基金赎回款          | -           | -     | -           |
| 本期已分配利润        | -760,023.25 | -     | -760,023.25 |
| 本期末            | -           | -     | -           |

注：本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配，每日以红利再投资方式支付累计收益，即按份额面值 1.00 元转为基金份额。

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 184,384,366.58                        |
| 定期存款利息收入  | 321,292,203.50                        |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 1,203.91                              |
| 其他        | 207.89                                |
| 合计        | 505,677,981.88                        |

**6.4.7.10 股票投资收益**

无。

**6.4.7.11 债券投资收益****6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 569,855,412.98             |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 37,400,123.12              |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | —                          |
| 债券投资收益——申购差价收入               | —                          |
| 合计                           | 607,255,536.10             |

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 112,657,902,440.08         |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 112,457,030,747.20         |
| 减：应计利息总额               | 163,471,031.26             |
| 减：交易费用                 | 538.50                     |
| 买卖债券差价收入               | 37,400,123.12              |

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.13 衍生工具收益****6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**6.4.7.14 股利收益**

无。

**6.4.7.15 公允价值变动收益**

无。

6.4.7.16 其他收入

无。

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 49,588.57                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 汇划手续费   | 137,586.49                            |
| 账户维护费   | 17,853.84                             |
| 其他      | 600.00                                |
| 合计      | 265,136.27                            |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系             |
|------------------------|---------------------|
| 中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）     | 基金管理人、基金销售机构、注册登记机构 |
| 中国民生银行股份有限公司           | 基金托管人、基金销售机构        |
| 自然人股东                  | 基金管理人的股东            |
| 上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”） | 基金管理人的控股子公司、基金销售机构  |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年<br>6 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 213,448,616.85                           | 183,657,699.41                                |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 106,707,953.56                           | 91,815,027.32                                 |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 106,740,663.29                           | 91,842,672.09                                 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.28% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.28\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年<br>6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 38,115,824.41                            | 32,796,017.71                                 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.05\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                              |              |              |            |
|----------------|---------------------------------|--------------|--------------|------------|
|                | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |              |              |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |              |              |            |
|                | 中欧滚钱宝货币<br>A                    | 中欧滚钱宝货币<br>B | 中欧滚钱宝货币<br>C | 合计         |
| 中国民生银行股份有限公司   | 87,412.40                       | 0.00         | 0.00         | 87,412.40  |
| 中欧财富           | 313,046.77                      | 0.00         | 0.00         | 313,046.77 |
| 中欧基金           | 1.54                            | 292.81       | 99.19        | 393.54     |
| 合计             | 400,460.71                      | 292.81       | 99.19        | 400,852.71 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                         |              |              |            |
|                | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |              |              |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |              |              |            |
|                | 中欧滚钱宝货币<br>A                    | 中欧滚钱宝货币<br>B | 中欧滚钱宝货币<br>C | 合计         |
| 中国民生银行股份有限公司   | 138,875.46                      | 0.00         | 0.00         | 138,875.46 |
| 中欧财富           | 236,914.55                      | 0.00         | 0.00         | 236,914.55 |
| 中欧基金           | 1.71                            | 288.27       | 48.49        | 338.47     |
| 合计             | 375,791.72                      | 288.27       | 48.49        | 376,128.48 |

注：本基金 A 类基金份额的销售服务费按前一日该类基金份额基金资产净值的 0.25%年费率计提。本基金 B 类基金份额的销售服务费按前一日该类基金份额基金资产净值的 0.01%年费率计提。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日该类基金份额基金资产净值的 0.25%。

销售服务费计提的计算公式具体如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额的年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日的该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发

送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月 5 个工作日内根据划款指令从基金财产中一次性支付登记机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中欧滚钱宝货币 B

份额单位：份

| 项目                  | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 报告期初持有的基金份额         | 5,870,524.98                          | 5,786,138.72                               |
| 报告期间申购/买入总份额        | 37,252.98                             | 44,610.39                                  |
| 报告期间因拆分变动份额         | 0.00                                  | 0.00                                       |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | 0.00                                  | 0.00                                       |
| 报告期末持有的基金份额         | 5,907,777.96                          | 5,830,749.11                               |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 99.88%                                | 99.97%                                     |

注：1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、基金管理人通过相关销售商渠道投资本基金各类基金份额，适用费率符合本基金招募说明

书和相关公告的规定。

3、本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金 A 类基金份额、C 类基金份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧滚钱宝货币 A

| 关联方名称 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |                      | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |                      |
|-------|------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
|       | 持有的<br>基金份额            | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例 |
| 中欧财富  | 120,864.65             | 0.00%                | 103,369.60               | 0.00%                |
| 自然人股东 | 3,533,081.05           | 0.00%                | 2,012,335.09             | 0.00%                |

份额单位：份

中欧滚钱宝货币 C

| 关联方名称 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |                      | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |                      |
|-------|------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
|       | 持有的<br>基金份额            | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例 |
| 中欧财富  | 6,262.31               | 0.00%                | 9,711.25                 | 0.01%                |

注：1、除基金管理人之外的其他关联方投资本基金各类基金份额的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

2、本报告期期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金 B 类基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |               |
|--------------|---------------------------------------|----------------|--------------------------------------------|---------------|
|              | 期末余额                                  | 当期利息收入         | 期末余额                                       | 当期利息收入        |
| 中国民生银行股份有限公司 | 3,001,569,436.42                      | 100,516,498.06 | 13,007,433,427.66                          | 53,740,319.80 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行股份有限公司保管，按银行同业利率/约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金未持有中国民生银行股份有限公司发行的同业存单（于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有中国民生银行股份有限公司发行的同业存单账面价值为人民币 3,280,182,927.29

元，占基金资产净值的比例为 2.20%)。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 中欧滚钱宝货币 A        |                   |              |                |    |
|------------------|-------------------|--------------|----------------|----|
| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计   | 备注 |
| 787,907,364.76   | -                 | -            | 787,907,364.76 | -  |
| 中欧滚钱宝货币 B        |                   |              |                |    |
| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计   | 备注 |
| 37,301.21        | -                 | -            | 37,301.21      | -  |
| 中欧滚钱宝货币 C        |                   |              |                |    |
| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计   | 备注 |
| 760,023.25       | -                 | -            | 760,023.25     | -  |

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 9,000,356,079.56 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称              | 回购到期日             | 期末估值单<br>价 | 数量（张）      | 期末估值总额           |
|-----------|-------------------|-------------------|------------|------------|------------------|
| 09250409  | 25 农发清<br>发 09    | 2026 年 7 月 1<br>日 | 100.14     | 44,824,000 | 4,488,838,656.30 |
| 112517269 | 25 光大银<br>行 CD269 | 2026 年 7 月 1<br>日 | 99.31      | 1,000,000  | 99,314,088.98    |
| 112603134 | 26 农业银<br>行 CD134 | 2026 年 7 月 1<br>日 | 99.39      | 5,320,000  | 528,740,100.49   |
| 112605151 | 26 建设银<br>行 CD151 | 2026 年 7 月 1<br>日 | 98.97      | 5,000,000  | 494,845,160.84   |
| 112605161 | 26 建设银<br>行 CD161 | 2026 年 7 月 1<br>日 | 99.31      | 5,912,000  | 587,142,425.05   |
| 112609044 | 26 浦发银<br>行 CD044 | 2026 年 7 月 1<br>日 | 99.47      | 1,000,000  | 99,467,620.83    |

|           |               |                |        |            |                  |
|-----------|---------------|----------------|--------|------------|------------------|
| 112610114 | 26 兴业银行 CD114 | 2026 年 7 月 1 日 | 99.69  | 20,000,000 | 1,993,789,846.01 |
| 112617009 | 26 光大银行 CD009 | 2026 年 7 月 1 日 | 99.17  | 1,000,000  | 99,169,415.33    |
| 112617034 | 26 光大银行 CD034 | 2026 年 7 月 1 日 | 98.96  | 1,000,000  | 98,963,122.49    |
| 112617037 | 26 光大银行 CD037 | 2026 年 7 月 1 日 | 98.95  | 1,000,000  | 98,947,969.76    |
| 112617039 | 26 光大银行 CD039 | 2026 年 7 月 1 日 | 98.93  | 2,000,000  | 197,864,258.03   |
| 112618053 | 26 华夏银行 CD053 | 2026 年 7 月 1 日 | 99.01  | 1,000,000  | 99,014,129.91    |
| 112620042 | 26 广发银行 CD042 | 2026 年 7 月 1 日 | 98.99  | 1,556,000  | 154,028,769.01   |
| 112621224 | 26 渤海银行 CD224 | 2026 年 7 月 1 日 | 99.32  | 5,617,000  | 557,877,967.04   |
| 212380032 | 24 浦发银行债 01   | 2026 年 7 月 1 日 | 101.31 | 2,223,000  | 225,210,929.16   |
| 合计        |               |                |        | 98,452,000 | 9,823,214,459.23 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在综合考虑基金资产收益性、安全性和较高流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的稳定收益。 本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查和反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风

险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在承受的范围之内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | —                      | 423,677,176.52           |
| A-1 以下 | —                      | —                        |
| 未评级    | 270,807,395.99         | 1,645,157,138.83         |
| 合计     | 270,807,395.99         | 2,068,834,315.35         |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为期限在一年以下未有三方评级的超短期融资债券。3. 债券投资以成本价列示。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期与上期末基金均未持有短期信用评级的资产支持证券。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 63,362,762,027.79      | 87,806,516,493.83        |
| A-1 以下 | —                      | —                        |
| 未评级    | —                      | —                        |
| 合计     | 63,362,762,027.79      | 87,806,516,493.83        |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的主体评级。2. 债券投资以成本价列示。3. A-1 为 AAA，A-1 以下为 AAA 以下。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 1,414,622,482.68       | 3,000,201,689.18         |
| AAA 以下 | 51,482,314.09          | 61,719,932.35            |
| 未评级    | 4,586,578,851.92       | 233,587,762.76           |
| 合计     | 6,052,683,648.69       | 3,295,509,384.29         |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为期限在一年以上未有三方评级的政策银行债。3. 债券投资以成本价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期与上期末基金均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期与上期末基金均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基

金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的定期存款，固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注 6.4.12 披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 6 个月以内            | 6 个月-1 年          | 1-5 年 | 不计息       | 合计                 |
|------------------------|-------------------|-------------------|-------|-----------|--------------------|
| 资产                     |                   |                   |       |           |                    |
| 货币资金                   | 54,387,489,704.45 | 6,504,189,166.81  | -     | -         | 60,891,678,871.26  |
| 存出保证金                  | 207,748.83        | -                 | -     | -         | 207,748.83         |
| 交易性金融资产                | 45,387,899,022.95 | 24,298,354,049.52 | -     | -         | 69,686,253,072.47  |
| 买入返售金融资产               | 32,151,200,905.95 | -                 | -     | -         | 32,151,200,905.95  |
| 应收申购款                  | -                 | -                 | -     | 24,741.48 | 24,741.48          |
| 资产总计                   | 131,926,797,383   | 30,802,543,216    | -     | 24,741.48 | 162,729,365,339.99 |

|                          |                    |                   |       |               |                    |
|--------------------------|--------------------|-------------------|-------|---------------|--------------------|
|                          | 2.18               | .33               |       |               |                    |
| 负债                       |                    |                   |       |               |                    |
| 应付赎回款                    | -                  | -                 | -     | 156,467.62    | 156,467.62         |
| 应付管理人报酬                  | -                  | -                 | -     | 35,512,788.82 | 35,512,788.82      |
| 应付托管费                    | -                  | -                 | -     | 6,341,569.42  | 6,341,569.42       |
| 卖出回购金融资产款                | 9,000,356,079.56   | -                 | -     | -             | 9,000,356,079.56   |
| 应付销售服务费                  | -                  | -                 | -     | 31,706,680.97 | 31,706,680.97      |
| 应交税费                     | -                  | -                 | -     | 21,740.84     | 21,740.84          |
| 其他负债                     | -                  | -                 | -     | 1,504,292.02  | 1,504,292.02       |
| 负债总计                     | 9,000,356,079.56   | -                 | -     | 75,243,539.69 | 9,075,599,619.25   |
| 利率敏感度缺口                  | 122,926,441,302.62 | 30,802,543,216.33 | -     | 75,218,798.21 | 153,653,765,720.74 |
| 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 | 6 个月以内             | 6 个月<br>-1 年      | 1-5 年 | 不计息           | 合计                 |
| 资产                       |                    |                   |       |               |                    |
| 货币资金                     | 39,683,649,529.23  | 2,801,438,055.60  | -     | -             | 42,485,087,584.83  |
| 结算备付金                    | 101,532.38         | -                 | -     | -             | 101,532.38         |
| 存出保证金                    | 58,797.61          | -                 | -     | -             | 58,797.61          |
| 交易性金融资产                  | 85,419,324,925.49  | 7,751,535,267.98  | -     | -             | 93,170,860,193.47  |
| 买入返售金融资产                 | 16,016,605,203.28  | -                 | -     | -             | 16,016,605,203.28  |
| 应收申购款                    | -                  | -                 | -     | 585,404.39    | 585,404.39         |
| 资产总计                     | 141,119,739,987.99 | 10,552,973,323.58 | -     | 585,404.39    | 151,673,298,715.96 |
| 负债                       |                    |                   |       |               |                    |
| 应付赎回款                    | -                  | -                 | -     | 1,210.03      | 1,210.03           |
| 应付管理人报酬                  | -                  | -                 | -     | 35,609,900.43 | 35,609,900.43      |
| 应付托管费                    | -                  | -                 | -     | 6,358,910.79  | 6,358,910.79       |
| 卖出回购金融资产款                | 2,339,094,822.91   | -                 | -     | -             | 2,339,094,822.91   |
| 应付销售服务费                  | -                  | -                 | -     | 31,793,067.38 | 31,793,067.38      |
| 应交税费                     | -                  | -                 | -     | 57,260.64     | 57,260.64          |
| 其他负债                     | -                  | -                 | -     | 746,164.10    | 746,164.10         |
| 负债总计                     | 2,339,094,822.91   | -                 | -     | 74,566,513.37 | 2,413,661,336.28   |
| 利率敏感度缺口                  | 138,780,645,165.08 | 10,552,973,323.58 | -     | 73,981,108.98 | 149,259,637,379.68 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|--------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                    | 本期末（2026 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2025 年 12 月 31 日） |
|    | 利率上升 25BP          | -87,340,826.06              | -72,754,075.50         |
|    | 利率下降 25BP          | 87,570,889.97               | 72,894,934.40          |

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%（2025 年 12 月 31 日：0.00%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | —                      | —                        |
| 第二层次          | 69,686,253,072.47      | 93,170,860,193.47        |
| 第三层次          | —                      | —                        |
| 合计            | 69,686,253,072.47      | 93,170,860,193.47        |

**6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

**6.4.15.1 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

**6.4.15.2 其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

**6.4.15.3 财务报表的批准**

本财务报表已于 2026 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

**§ 7 投资组合报告**

**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目         | 金额                | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|------------|-------------------|---------------|
| 1  | 固定收益投资     | 69,686,253,072.47 | 42.82         |
|    | 其中：债券      | 69,686,253,072.47 | 42.82         |
|    | 资产支持证<br>券 | —                 | —             |

|   |                       |                    |        |
|---|-----------------------|--------------------|--------|
| 2 | 买入返售金融资产              | 32,151,200,905.95  | 19.76  |
|   | 其中：买断式回购的<br>买入返售金融资产 | —                  | —      |
| 3 | 银行存款和结算备<br>付金合计      | 60,891,678,871.26  | 37.42  |
| 4 | 其他各项资产                | 232,490.31         | 0.00   |
| 5 | 合计                    | 162,729,365,339.99 | 100.00 |

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值的比例（%）    |                   |
|----|--------------|------------------|-------------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 5.64             |                   |
|    | 其中：买断式回购融资   | —                |                   |
| 序号 | 项目           | 金额               | 占基金资产净值的<br>比例（%） |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | 9,000,356,079.56 | 5.86              |
|    | 其中：买断式回购融资   | —                | —                 |

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数  |
|-------------------|-----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 119 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 119 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 53  |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限                     | 各期限资产占基金资产<br>净值的比例（%） | 各期限负债占基金资产<br>净值的比例（%） |
|----|----------------------------|------------------------|------------------------|
| 1  | 30 天以内                     | 26.92                  | 5.86                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | —                      | —                      |
| 2  | 30 天（含）—60 天               | 8.72                   | —                      |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | —                      | —                      |
| 3  | 60 天（含）—90 天               | 9.95                   | —                      |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的          | —                      | —                      |

|    |                            |        |      |
|----|----------------------------|--------|------|
|    | 浮动利率债                      |        |      |
| 4  | 90 天（含）—120 天              | 6.59   | —    |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | —      | —    |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）          | 53.60  | —    |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | —      | —    |
| 合计 |                            | 105.77 | 5.86 |

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种                             | 公允价值              | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------------------------------|-------------------|--------------|
| 1  | 国家债券                             | —                 | —            |
| 2  | 央行票据                             | —                 | —            |
| 3  | 金融债券                             | 5,950,034,705.94  | 3.87         |
|    | 其中：政策性<br>金融债                    | 4,586,578,851.92  | 2.99         |
| 4  | 企业债券                             | 51,166,628.66     | 0.03         |
| 5  | 企业短期融<br>资券                      | 270,807,395.99    | 0.18         |
| 6  | 中期票据                             | 51,482,314.09     | 0.03         |
| 7  | 同业存单                             | 63,362,762,027.79 | 41.24        |
| 8  | 其他                               | —                 | —            |
| 9  | 合计                               | 69,686,253,072.47 | 45.35        |
| 10 | 剩余存续期<br>超过 397 天的<br>浮动利率债<br>券 | —                 | —            |

注：上表中，附息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称             | 债券数量<br>（张） | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|-------------|------------------|--------------|
| 1  | 09250409  | 25 农发清发<br>09    | 45,800,000  | 4,586,578,851.92 | 2.99         |
| 2  | 112610114 | 26 兴业银行<br>CD114 | 20,000,000  | 1,993,789,846.01 | 1.30         |
| 3  | 112603134 | 26 农业银行          | 20,000,000  | 1,987,744,738.70 | 1.29         |

|    |           |                  |            |                  |      |
|----|-----------|------------------|------------|------------------|------|
|    |           | CD134            |            |                  |      |
| 4  | 112621224 | 26 渤海银行<br>CD224 | 20,000,000 | 1,986,391,194.74 | 1.29 |
| 5  | 112603146 | 26 农业银行<br>CD146 | 20,000,000 | 1,986,310,945.47 | 1.29 |
| 6  | 112603127 | 26 农业银行<br>CD127 | 15,000,000 | 1,496,730,224.12 | 0.97 |
| 7  | 112603128 | 26 农业银行<br>CD128 | 15,000,000 | 1,491,361,460.79 | 0.97 |
| 8  | 112605161 | 26 建设银行<br>CD161 | 15,000,000 | 1,489,705,070.32 | 0.97 |
| 9  | 112614072 | 26 江苏银行<br>CD072 | 15,000,000 | 1,487,732,662.33 | 0.97 |
| 10 | 112693743 | 26 重庆银行<br>CD012 | 15,000,000 | 1,482,796,650.25 | 0.97 |

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

| 项目                            | 偏离情况     |
|-------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数 | 0        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0301%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0004% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0162%  |

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1

本基金按照实际利率计算账面价值，即计价对象以买入成本列示，按实际利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.000 元。

#### 7.9.2

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督

管理总局的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。重庆银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局重庆监管局、国家外汇管理局重庆市分局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其余前十大持有证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额         |
|----|-------|------------|
| 1  | 存出保证金 | 207,748.83 |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 3  | 应收利息  | -          |
| 4  | 应收申购款 | 24,741.48  |
| 5  | 其他应收款 | -          |
| 6  | 待摊费用  | -          |
| 7  | 其他    | -          |
| 8  | 合计    | 232,490.31 |

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别      | 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基金<br>份额 | 持有人结构        |            |                    |            |
|-----------|--------------|---------------|--------------|------------|--------------------|------------|
|           |              |               | 机构投资者        |            | 个人投资者              |            |
|           |              |               | 持有份额         | 占总份<br>额比例 | 持有份额               | 占总份<br>额比例 |
| 中欧滚钱宝货币 A | 15,166,905   | 10,120.25     | 120,867.70   | 0.00%      | 153,492,772,581.28 | 100.00%    |
| 中欧滚钱宝货币 B | 5            | 1,182,981.82  | 5,907,965.44 | 99.88%     | 6,943.64           | 0.12%      |
| 中欧滚钱宝货    | 92,553       | 1,674.26      | 6,262.47     | 0.00%      | 154,951,100.21     | 100.00%    |

|     |            |           |              |       |                    |         |
|-----|------------|-----------|--------------|-------|--------------------|---------|
| 币 C |            |           |              |       |                    |         |
| 合计  | 15,259,463 | 10,069.41 | 6,035,095.61 | 0.00% | 153,647,730,625.13 | 100.00% |

## 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额（份）       | 占总份额比例（%） |
|----|-------|---------------|-----------|
| 1  | 个人    | 24,174,100.96 | 0.02      |
| 2  | 个人    | 21,623,407.14 | 0.01      |
| 3  | 个人    | 19,972,658.21 | 0.01      |
| 4  | 个人    | 18,741,945.27 | 0.01      |
| 5  | 个人    | 17,906,043.19 | 0.01      |
| 6  | 个人    | 16,411,061.20 | 0.01      |
| 7  | 个人    | 15,211,010.92 | 0.01      |
| 8  | 个人    | 14,532,579.41 | 0.01      |
| 9  | 个人    | 14,293,204.11 | 0.01      |
| 10 | 个人    | 12,649,706.04 | 0.01      |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别      | 持有份额总数（份）     | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|---------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 中欧滚钱宝货币 A | 10,619,162.12 | 0.01%    |
|                  | 中欧滚钱宝货币 B | 0.00          | 0.00%    |
|                  | 中欧滚钱宝货币 C | 575.22        | 0.00%    |
|                  | 合计        | 10,619,737.34 | 0.01%    |

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别      | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 中欧滚钱宝货币 A | >100              |
|                                | 中欧滚钱宝货币 B | 0                 |
|                                | 中欧滚钱宝货币 C | 0                 |
|                                | 合计        | >100              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 中欧滚钱宝货币 A | 0~10              |
|                                | 中欧滚钱宝货币 B | 0                 |
|                                | 中欧滚钱宝货币 C | 0                 |
|                                | 合计        | 0~10              |

## 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立已满三年，本报告期内无发起式资金持有份额情况。

# § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 中欧滚钱宝货币 A          | 中欧滚钱宝货币 B    | 中欧滚钱宝货币 C      |
|--------------------------------|--------------------|--------------|----------------|
| 基金合同生效日（2015 年 6 月 12 日）基金份额总额 | 40,000,000.00      | —            | —              |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 149,110,340,564.89 | 5,875,602.22 | 143,421,212.57 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 692,407,422,266.24 | 50,569.25    | 166,298,569.71 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 688,024,869,382.15 | 11,262.39    | 154,762,419.60 |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | —                  | —            | —              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 153,492,893,448.98 | 5,914,909.08 | 154,957,362.68 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期无涉及基金财产的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人不存在受调查或处罚的情况。

### 10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员不存在受调查或处罚的情况。

### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，未收到关于证券投资基金托管业务受调查或处罚的情况。

### 10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未收到证券投资基金托管业务相关从业人员受调查或处罚的情况。

## 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

### 10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 东北证券 | 1      | —    | —                | —         | —              | —  |
| 国都证券 | 1      | —    | —                | —         | —              | —  |
| 国金证券 | 2      | —    | —                | —         | —              | —  |
| 中信证券 | 1      | —    | —                | —         | —              | —  |

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况的基础上，选择基金专用交易席位。

### 10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |                  | 债券回购交易 |                    | 权证交易 |                  |
|------|------|------------------|--------|--------------------|------|------------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 东北证券 | —    | —                | —      | —                  | —    | —                |
| 国都证券 | —    | —                | —      | —                  | —    | —                |

|          |                          |        |   |   |   |   |
|----------|--------------------------|--------|---|---|---|---|
| 国金证<br>券 | 3, 106, 002, 1<br>26. 67 | 95. 57 | - | - | - | - |
| 中信证<br>券 | 144, 093, 964<br>. 25    | 4. 43  | - | - | - | - |

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况的基础上，选择基金专用交易席位。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度绝对值不存在超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                           | 法定披露方式    | 法定披露日期     |
|----|------------------------------------------------|-----------|------------|
| 1  | 中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第四季度报告的提示性公告            | 中国证监会指定媒介 | 2026-01-22 |
| 2  | 中欧滚钱宝发起式货币市场基金 2025 年第 4 季度报告                  | 中国证监会指定媒介 | 2026-01-22 |
| 3  | 中欧基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）     | 中国证监会指定媒介 | 2026-03-31 |
| 4  | 中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告的提示性公告              | 中国证监会指定媒介 | 2026-03-31 |
| 5  | 中欧滚钱宝发起式货币市场基金 2025 年年度报告                      | 中国证监会指定媒介 | 2026-03-31 |
| 6  | 中欧滚钱宝发起式货币市场基金 2026 年第 1 季度报告                  | 中国证监会指定媒介 | 2026-04-22 |
| 7  | 中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第一季度报告的提示性公告            | 中国证监会指定媒介 | 2026-04-22 |
| 8  | 中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金产品资料概要更新                       | 中国证监会指定媒介 | 2026-05-20 |
| 9  | 中欧基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告 | 中国证监会指定媒介 | 2026-06-06 |
| 10 | 中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金经理变更公告                         | 中国证监会指定媒介 | 2026-06-09 |
| 11 | 中欧滚钱宝发起式货币市场基金更新招募说明书（2025 年 6 月）              | 中国证监会指定媒介 | 2026-06-09 |
| 12 | 中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金产品资料概要更新                       | 中国证监会指定媒介 | 2026-06-09 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、本基金批复文件、基金合同、托管协议、招募说明书及更新；
- 2、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 3、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

### 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站([www.zofund.com](http://www.zofund.com))查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日